



【2023-02-20】

国债

今日以利率招标方式开展了 2700 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 2.0%。今日 460 亿元逆回购到期，因此当日净投放 2240 亿元。同时，中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心公布，2023 年 2 月 20 日贷款市场报价利率（LPR）为：1 年期 LPR 为 3.65%，5 年期以上 LPR 为 4.3%。

国债方面 7D 229969 1.90，84D 239909 2.07，247D 220023 2.16，1.13Y 210004 2.17-2.175，1.84Y 220028 2.42-2.45，2.76Y 220026 2.53-2.5575，3.45Y 160017 2.615-2.625，4.65Y 220022 2.6725-2.6975，5.65Y 210013 2.755-2.76，6.82Y 220027 2.855-2.875，9.73Y 220025 2.89-2.915，29.15Y 220008 3.28-3.30

|         | 1      | 3      | 5      | 7      | 10     | 30     |
|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 昨日国债(%) | 2.1000 | 2.4350 | 2.6650 | 2.8100 | 2.8900 | 3.2800 |
| 今日国债(%) | 2.1600 | 2.4400 | 2.7000 | 2.8300 | 2.9175 | 3.3000 |
| 变动(%)   | 0.0600 | 0.0050 | 0.0350 | 0.0200 | 0.0275 | 0.0200 |

金融债

金融债方面 78D 220304 2.09，106D 220404 2.115-2.12，267D 220308 2.36-2.39，346D 190203 2.41-2.47，1.11Y 210303 2.47，1.79Y 220332 2.61-2.66，2.39Y 200212 2.715-2.73，3.03Y 210203 2.73-2.785，4.32Y 220208 2.84-2.8925，6.25Y 190210 3.00-3.025，9.17Y 220210 3.07-3.08，9.67Y 220220 3.056-3.09，2.93Y 160205 3.23-3.24

|            | 1      | 3      | 5      | 7      | 10     |
|------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 昨日非国金融债(%) | 2.3600 | 2.6400 | 2.8675 | 2.9725 | 3.0750 |
| 今日非国金融债(%) | 2.4125 | 2.7000 | 2.9050 | 2.9850 | 3.0900 |
| 变动(%)      | 0.0525 | 0.0600 | 0.0375 | 0.0125 | 0.0150 |
| 昨日国开债(%)   | 2.3500 | 2.6050 | 2.8400 | 2.9900 | 3.0625 |
| 今日国开债(%)   | 2.3700 | 2.6700 | 2.8950 | 3.0250 | 3.0925 |
| 变动(%)      | 0.0200 | 0.0650 | 0.0550 | 0.0350 | 0.0300 |



短期融资券

今日短融交投情绪较为活跃，成交主要集中在各期限 AAA AA+短融产品。短端方面，9D 012380369 23 京国资 SCP002 AAA 成交在 2.60%位置，银行出给银行，25D 012283878 22 鲁西化工 SCP005 AAA 成交在 2.59%位置，基金出给理财；中长端方面，144D 012380264 23 华润置地 SCP001 AAA 成交在 2.75%位置，基金出给基金；179D 012380582(02.21 上市) 23 昆山创业 SCP002 AAA 成交在 100 净价位置，券商出给基金；长端方面，204D 012380546 23 建发 SCP002 AAA 成交在 2.95%位置，银行出给基金，263D 012380466 23 江西交投 SCP002 AAA 成交在 2.68%位置，基金出给券商资管；总体而言，今日短融收益震荡。

|                       | 评级  | 1M   |   | 3M   |   | 6M   |    | 9M   |    | 12M  |    |
|-----------------------|-----|------|---|------|---|------|----|------|----|------|----|
| 绝对收益率                 | AAA | 2.38 |   | 2.5  |   | 2.58 |    | 2.82 |    | 2.98 |    |
|                       | AA+ | 2.58 |   | 2.85 |   | 3    |    | 3.06 |    | 3.2  |    |
|                       | AA  | 3.2  |   | 3.45 |   | 3.85 |    | 4    |    | 4.2  |    |
|                       | AA- | 3.65 |   | 4    |   | 4.45 |    | 4.65 |    | 4.9  |    |
| 与昨日收益变动对照<br><br>(BP) | AAA | 2.38 | 0 | 2.5  | 0 | 2.59 | -1 | 2.83 | -1 | 3    | -2 |
|                       | AA+ | 2.58 | 0 | 2.85 | 0 | 3    | 0  | 3.06 | 0  | 3.2  | 0  |
|                       | AA  | 3.2  | 0 | 3.45 | 0 | 3.86 | -1 | 4.06 | -6 | 4.23 | -3 |
|                       | AA- | 3.65 | 0 | 4    | 0 | 4.48 | -3 | 4.66 | -1 | 4.9  | 0  |



中期票据

今日中票交投情绪一般，买盘主要为基金和银行理财。1-3 年短端中票，22 中电投 MTN017 (AAA, 2.34Y) 成交在 3.00%，高估值 5bp 成交；22 招商蛇口 MTN002 (AAA, 2.04Y) 成交在 2.88%，高估值 3bp 成交；22 汇金 MTN004 (AAA, 2.72Y)在 3.0%成交；22 南电 MTN004 (AAA, 2.67Y)在 2.98%成交，高估值 2bp 成交。3 到 5 年期限，成交一般，22 汉江国资 MTN001 (4.87Y) 在 4.0%成交高估值 6bp 成交。5Y 及以上期限，成交寥寥。总体而言，今日中票成交收益率略有上行。

|                       | 评级   | 1y   |   | 3y   |   | 5y   |    | 7y   |      | 10y  |      |
|-----------------------|------|------|---|------|---|------|----|------|------|------|------|
| 绝对收益率                 | AAA+ | 2.72 |   | 3.02 |   | 3.24 |    | 3.48 |      | Null |      |
|                       | AAA  | 2.84 |   | 3.2  |   | 3.4  |    | 3.66 |      | Null |      |
|                       | AA+  | 3.07 |   | 3.79 |   | 4.1  |    | Null |      | Null |      |
|                       | AA   | 3.53 |   | 4.07 |   | 4.51 |    | Null |      | Null |      |
| 与昨日收益变动对照<br><br>(BP) | AAA+ | 2.69 | 3 | 3    | 2 | 3.22 | 2  | 3.47 | 1    | Null | Null |
|                       | AAA  | 2.82 | 2 | 3.17 | 3 | 3.37 | 3  | 3.65 | 1    | Null | Null |
|                       | AA+  | 3.06 | 1 | 3.78 | 1 | 4.09 | -2 | Null | Null | Null | Null |
|                       | AA   | 3.52 | 1 | 4.06 | 1 | 4.5  | -2 | Null | Null | Null | Null |



企业债

今日企业债交投较为活跃，基金，券商，银行，保险和券商资管均有参与。可质押方面，国电投 04 AAA 成交在 2.55%，基金卖出，基金买入。20 深铁 05 AAA 成交在 2.70%，基金卖出，银行买入。23 中证 G1 AAA 成交在 2.93%。城投方面，16 漕河泾 AA+ 成交在 2.62%，银行卖出，基金买入。21 鄂交 Y1 AAA 成交在 3.17%。G22 厦 01 AAA 成交在 3.35%。长端方面，22 信投 G2 AAA 成交在 3.26%。



美元债

受美国假期影响，市场交投清淡，投资整体无较大变化。城投版块，延续上周山东地区名字有银行买家，山东国惠，青岛国信，济南城建等均有买家出现，济南城建 24 成交在 6.45%。地产版块整体疲软，整体下跌 0.5-1pts，万达 DALWAN/路劲 ROADKG/仁恒 YLLGSP 等名字均有卖盘出现，中骏因评级下调影响，整体下跌 2-7pts。

今日短融成交

| 剩余天数      | 债券代码         | 债券代码（发行机构）     | 评级  | 收益率    |
|-----------|--------------|----------------|-----|--------|
| 4D        | 012284432.IB | 22 温州城建 SCP004 | AAA | 2.60%  |
| 4D        | 012284439.IB | 22 华能新能 SCP006 | AAA | 2.37%  |
| 9D        | 012380369.IB | 23 京国资 SCP002  | AAA | 2.60%  |
| 9D        | 012380369.IB | 23 京国资 SCP002  | AAA | 2.60%  |
| 9D        | 012380369.IB | 23 京国资 SCP002  | AAA | 2.60%  |
| 11D       | 042280108.IB | 22 青岛城投 CP001  | AAA | 3.00%  |
| 18D       | 012282088.IB | 22 嘉善国投 SCP001 | AA+ | 2.70%  |
| 24D       | 012284335.IB | 22 良渚文化 SCP005 | AA+ | 2.70%  |
| 25D       | 012283878.IB | 22 鲁西化工 SCP005 | AAA | 2.59%  |
| 40D(休 2)  | 012282360.IB | 22 中石油 SCP003  | AAA | 2.70%  |
| 65D       | 042280201.IB | 22 宜春城投 CP001  | AA  | 3.10%  |
| 65D       | 012282934.IB | 22 灵山 SCP004   | AA+ | 2.82%  |
| 65D       | 012380381.IB | 23 西安投资 SCP001 | AA+ | 3.18%  |
| 90D(休 1)  | 012380122.IB | 23 长电 SCP005   | AAA | 2.54%  |
| 99D       | 012284330.IB | 22 华发集团 SCP012 | AAA | 3.18%  |
| 124D(休 2) | 012283349.IB | 22 镇江旅游 SCP003 | AA  | 4.85%  |
| 144D      | 012380264.IB | 23 华润置地 SCP001 | AAA | 2.75%  |
| 169D      | 012283899.IB | 22 锡山经开 SCP006 | AA  | 3.16%  |
| 170D      | 012380436.IB | 23 渝医药 SCP002  | AA+ | 3.78%  |
| 179D      | 012380582.IB | 23 昆山创业 SCP002 | AAA | 100 净价 |
| 204D      | 012380546.IB | 23 建发 SCP002   | AAA | 2.94%  |
| 204D      | 012380546.IB | 23 建发 SCP002   | AAA | 2.94%  |

|      |              |                |         |       |
|------|--------------|----------------|---------|-------|
| 204D | 012380546.IB | 23 建发 SCP002   | AAA     | 2.95% |
| 204D | 012380546.IB | 23 建发 SCP002   | AAA     | 2.95% |
| 204D | 012380546.IB | 23 建发 SCP002   | AAA     | 2.95% |
| 204D | 012380546.IB | 23 建发 SCP002   | AAA     | 2.96% |
| 232D | 012380234.IB | 23 华媒 SCP001   | AA+     | 3.03% |
| 235D | 012380242.IB | 23 随州城投 SCP001 | AA      | 4.10% |
| 235D | 012380242.IB | 23 随州城投 SCP001 | AA      | 4.10% |
| 263D | 012380466.IB | 23 江西交投 SCP002 | AAA     | 2.68% |
| 263D | 012380466.IB | 23 江西交投 SCP002 | AAA     | 2.68% |
| 297D | 042280551.IB | 22 河钢集 CP002   | AAA/A-1 | 3.20% |
| 298D | 042280556.IB | 22 凤城河 CP002   | AA+     | 3.53% |
| 333D | 042380053.IB | 23 凤城河 CP001   | AA+     | 3.50% |



今日中票成交

| 剩余天数        | 债券代码         | 债券代码（发行机构）            | 评级  | 收益率   |
|-------------|--------------|-----------------------|-----|-------|
| 6D(休 1)     | 102100301.IB | 21 广州地铁 MTN004        | AAA | 2.80% |
| 6D(休 1)     | 102100301.IB | 21 广州地铁 MTN004        | AAA | 2.80% |
| 7D+NY(休 1)  | 102000168.IB | 20 首钢 MTN001A         | AAA | 3.15% |
| 31D         | 102100521.IB | 21 广州地铁 MTN007        | AAA | 2.53% |
| 31D         | 102100521.IB | 21 广州地铁 MTN007        | AAA | 2.53% |
| 35D+NY(休 1) | 102100568.IB | 21 中铁建投 MTN001        | AAA | 2.81% |
| 35D+NY(休 1) | 102100568.IB | 21 中铁建投 MTN001        | AAA | 2.71% |
| 40D(休 2)    | 102000568.IB | 20 中石化 MTN001         | AAA | 2.70% |
| 49D         | 102000608.IB | 20 湘投 MTN001A         | AA+ | 2.72% |
| 56D+2Y      | 102000716.IB | 20 深业 MTN002          | AAA | 2.64% |
| 77D+365D    | 102100938.IB | 21 大唐发电 MTN001(可持续挂钩) | AAA | 2.60% |
| 77D+365D    | 102100938.IB | 21 大唐发电 MTN001(可持续挂钩) | AAA | 2.60% |
| 91D         | 102001040.IB | 20 大同煤矿 MTN005        | AAA | 2.84% |
| 97D(休 1)    | 102001109.IB | 20 中石化 MTN003         | AAA | 2.58% |
| 116D        | 102001182.IB | 20 江苏沿海 MTN001        | AA  | 3.25% |
| 140D+2Y     | 102001342.IB | 20 佛公用 MTN003         | AAA | 2.72% |
| 144D        | 102100534.IB | 21 新华发行 MTN001        | AA+ | 3.45% |

|               |              |                 |        |       |
|---------------|--------------|-----------------|--------|-------|
| 150D+2Y(休 1)  | 101800783.IB | 18 北控水务 MTN002B | AAA    | 2.71% |
| 161D+NY(休 2)  | 102001430.IB | 20 陕煤化 MTN003   | AAA    | 3.25% |
| 161D+NY(休 2)  | 102001430.IB | 20 陕煤化 MTN003   | AAA    | 3.25% |
| 173D(休 2)     | 102001498.IB | 20 深圳资本 MTN001  | AAA    | 2.73% |
| 173D(休 2)     | 102001498.IB | 20 深圳资本 MTN001  | AAA    | 2.73% |
| 213D+NY       | 101801105.IB | 18 大同煤矿 MTN006  | AAA    | 3.80% |
| 229D+1.98Y    | 102001861.IB | 20 湘高速 MTN005   | AAA    | 2.85% |
| 234D          | 102102030.IB | 21 晋能煤业 MTN002  | AAA    | 2.93% |
| 252D          | 101801234.IB | 18 新盛建设 MTN004  | AAA    | 2.83% |
| 287D+364D     | 102103157.IB | 21 溧水产投 MTN002  | AA     | 3.71% |
| 292D(休 2)     | 102002252.IB | 20 岳阳建投 MTN001  | AA+    | 3.19% |
| 309D          | 101801556.IB | 18 大横琴 MTN002   | AAA    | 2.87% |
| 329D          | 102100073.IB | 21 锡交通 MTN001   | AAA    | 2.85% |
| 329D          | 102100073.IB | 21 锡交通 MTN001   | AAA    | 2.85% |
| 332D          | 101900068.IB | 19 湖北科投 MTN001  | AAA    | 2.85% |
| 332D          | 101900068.IB | 19 湖北科投 MTN001  | AAA    | 2.85% |
| 1Y+NY         | 102200107.IB | 22 鄂联投 MTN001   | AAA    | 4.46% |
| 1.05Y+2Y(休 1) | 102100347.IB | 21 川交投 MTN001   | AAA    | 2.84% |
| 1.08Y         | 102100508.IB | 21 鄂交投 MTN001   | AAA    | 2.98% |
| 1.08Y         | 102100508.IB | 21 鄂交投 MTN001   | AAA    | 2.98% |
| 1.08Y         | 102100508.IB | 21 鄂交投 MTN001   | AAA    | 2.98% |
| 1.08Y         | 102100508.IB | 21 鄂交投 MTN001   | AAA    | 2.98% |
| 1.09Y+NY      | 102280525.IB | 22 苏科技城 MTN002  | AA/AA+ | 3.99% |
| 1.14Y+2Y(休 1) | 102100654.IB | 21 青岛地铁 MTN001  | AAA    | 2.95% |
| 1.26Y         | 101900733.IB | 19 中铝 MTN001    | AAA    | 2.86% |
| 1.31Y         | 101900800.IB | 19 南昌城投 MTN002  | AAA    | 2.96% |
| 1.67Y         | 102102117.IB | 21 广州资管 MTN002  | AAA    | 3.26% |
| 2.03Y         | 102280419.IB | 22 河钢集 MTN003   | AAA    | 4.50% |
| 2.04Y         | 102280437.IB | 22 招商蛇口 MTN002A | AAA    | 2.88% |
| 2.04Y         | 102280437.IB | 22 招商蛇口 MTN002A | AAA    | 2.88% |
| 2.05Y+2Y      | 102280502.IB | 22 芜湖宜居 MTN001  | AA+    | 3.50% |
| 2.09Y         | 102280608.IB | 22 河钢集 MTN005   | AAA    | 4.51% |
| 2.09Y         | 132000012.IB | 20 重庆轨交 GN002   | AAA    | 3.15% |
| 2.34Y         | 102281375.IB | 22 中电投 MTN017   | AAA    | 3.00% |

|       |              |                |     |       |
|-------|--------------|----------------|-----|-------|
| 2.34Y | 102281375.IB | 22 中电投 MTN017  | AAA | 3.00% |
| 2.34Y | 102281375.IB | 22 中电投 MTN017  | AAA | 3.00% |
| 2.41Y | 102281593.IB | 22 南京地铁 MTN001 | AAA | 3.05% |
| 2.41Y | 102281593.IB | 22 南京地铁 MTN001 | AAA | 3.05% |
| 2.67Y | 102282326.IB | 22 武进经发 MTN005 | AA+ | 4.05% |
| 2.67Y | 102282336.IB | 22 南电 MTN004   | AAA | 2.98% |
| 2.67Y | 102282336.IB | 22 南电 MTN004   | AAA | 2.98% |
| 4.87Y | 102282800.IB | 22 汉江国资 MTN001 | AAA | 4.00% |

今日企业债成交

| 剩余天数         | 债券代码       | 债券代码（发行机构）   | 评级  | 收益率     |
|--------------|------------|--------------|-----|---------|
| 35D          | 149084.SZ  | 20 海康 01     | AAA | 2.55%   |
| 57D          | 143309.SH  | 18 苏通 01     | AAA | 2.55%   |
| 57D          | 143309.SH  | 18 苏通 01     | AAA | 2.55%   |
| 66D          | 163495.SH  | 20 一汽 01     | AAA | 2.55%   |
| 73D+1.99Y    | 166660.SH  | 20 桐庐 01     | AA  | 3.50%   |
| 81D          | 188101.SH  | 国电投 04       | AAA | 2.55%   |
| 98D+2Y       | 163575.SH  | 20 鲁金 01     | AAA | 2.8773% |
| 102D         | 136462.SH  | 16 漕河泾       | AA+ | 2.62%   |
| 102D         | 136462.SH  | 16 漕河泾       | AA+ | 2.62%   |
| 111D(休 1)    | 143669.SH  | 18 宁开控       | AA+ | 2.78%   |
| 111D(休 1)    | 143669.SH  | 18 宁开控       | AA+ | 2.78%   |
| 130D+1Y(休 1) | 178925.SH  | 21 城发 04     | AA+ | 4.52%   |
| 140D+2Y      | 163701.SH  | 20 广药 01     | AAA | 2.62%   |
| 140D+2Y      | 163701.SH  | 20 广药 01     | AAA | 2.62%   |
| 165D+2Y      | 149189.SZ  | 20 大悦 01     | AAA | 3.05%   |
| 167D(休 1)    | 167335.SH  | 20 南沙 01     | AA  | 3.59%   |
| 177D         | 150617.SH  | 18 江公 01     | AA+ | 3.14%   |
| 205D+5Y      | 1828008.IB | 18 中信银行二级 01 | AAA | 2.80%   |
| 242D         | 149265.SZ  | 20 深铁 05     | AAA | 2.70%   |
| 245D+12Y     | 175274.SH  | 20 兖煤 04     | AAA | 2.83%   |
| 248D         | 1680426.IB | 16 瓯海新城债     | AA  | 3.30%   |
| 248D         | 149274.SZ  | 20 申证 10     | AAA | 2.67%   |
| 248D         | 149274.SZ  | 20 申证 10     | AAA | 2.67%   |
| 252D+5Y(休 1) | 1828013.IB | 18 建设银行二级 02 | AAA | 2.78%   |

|               |            |              |         |       |
|---------------|------------|--------------|---------|-------|
| 252D+5Y(休 1)  | 1828013.IB | 18 建设银行二级 02 | AAA     | 2.80% |
| 252D+5Y(休 1)  | 1828013.IB | 18 建设银行二级 02 | AAA     | 2.80% |
| 266D+1.99Y    | 177102.SH  | 20 阿地 01     | AA+     | 4.08% |
| 326D          | 114710.SH  | 23 新昌 D1     | AA+     | 3.93% |
| 1.06Y+2Y      | 178039.SH  | 21 太新 02     | AAA     | 3.03% |
| 1.06Y         | 155215.SH  | 19 北汽 01     | AAA     | 3.44% |
| 1.06Y         | 155215.SH  | 19 北汽 01     | AAA     | 3.44% |
| 1.09Y(休 1)    | 2128010.IB | 21 光大银行小微债   | AAA     | 2.72% |
| 1.09Y(休 1)    | 2128010.IB | 21 光大银行小微债   | AAA     | 2.72% |
| 1.09Y(休 1)    | 2128010.IB | 21 光大银行小微债   | AAA     | 2.71% |
| 1.09Y(休 1)    | 2128010.IB | 21 光大银行小微债   | AAA     | 2.71% |
| 1.09Y(休 1)    | 2128010.IB | 21 光大银行小微债   | AAA     | 2.71% |
| 1.13Y         | 2128013.IB | 21 交通银行小微债   | AAA     | 2.72% |
| 1.14Y         | 127488.SH  | PR 惠通投       | AA/AAA  | 3.10% |
| 1.3Y(休 1)     | 2128023.IB | 21 中信银行小微债   | AAA     | 2.80% |
| 1.3Y(休 1)     | 2128023.IB | 21 中信银行小微债   | AAA     | 2.80% |
| 1.3Y(休 1)     | 2128023.IB | 21 中信银行小微债   | AAA     | 2.75% |
| 1.35Y         | 196502.SH  | 21 东海 F2     | AA+     | 3.80% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.39Y+5Y      | 1920046.IB | 19 宁波银行二级    | AAA     | 3.20% |
| 1.43Y(休 1)    | 2128024.IB | 21 中国银行 02   | AAA     | 2.80% |
| 1.51Y         | 188612.SH  | 21 安信 C2     | AAA     | 3.20% |
| 1.53Y         | 149220.SZ  | 20 荣盛 G2     | AAA     | 4.10% |
| 1.56Y+5Y      | 1921030.IB | 19 深圳农商二级 01 | AAA/AA+ | 3.60% |
| 1.75Y+5Y      | 1928033.IB | 19 中国银行二级 03 | AAA     | 3.06% |
| 1.75Y+5Y      | 1928033.IB | 19 中国银行二级 03 | AAA     | 3.06% |
| 1.81Y+NY      | 138728.SH  | 中色 YK01      | AAA     | 3.75% |
| 2.16Y+5Y(休 2) | 2020022.IB | 20 南京银行二级 01 | AAA     | 3.46% |

|               |            |               |         |        |
|---------------|------------|---------------|---------|--------|
| 2.22Y+NY      | 2028017.IB | 20 农业银行永续债 01 | AAA     | 3.32%  |
| 2.38Y+NY      | 2028023.IB | 20 招商银行永续债 01 | AAA     | 3.49%  |
| 2.38Y+NY      | 2028023.IB | 20 招商银行永续债 01 | AAA     | 3.49%  |
| 2.38Y+NY      | 2028023.IB | 20 招商银行永续债 01 | AAA     | 3.45%  |
| 2.41Y(休 2)    | 196384.SH  | 22 霍邱 01      | AA/AAA  | 4.90%  |
| 2.45Y+5Y(休 2) | 2028025.IB | 20 浦发银行二级 01  | AAA     | 3.39%  |
| 2.45Y+5Y(休 2) | 2028025.IB | 20 浦发银行二级 01  | AAA     | 3.36%  |
| 2.45Y+5Y(休 2) | 2028025.IB | 20 浦发银行二级 01  | AAA     | 3.33%  |
| 2.46Y+5Y      | 2020043.IB | 20 苏州银行二级     | AAA/AA+ | 3.83%  |
| 2.48Y+5Y      | 2028024.IB | 20 中信银行二级     | AAA     | 3.35%  |
| 2.48Y+5Y      | 2028024.IB | 20 中信银行二级     | AAA     | 3.35%  |
| 2.55Y+NY      | 137772.SH  | 22 交投 Y2      | AAA     | 3.61%  |
| 2.56Y+5Y(休 2) | 2028033.IB | 20 建设银行二级     | AAA     | 3.30%  |
| 2.56Y+5Y(休 2) | 2028033.IB | 20 建设银行二级     | AAA     | 3.27%  |
| 2.58Y+5Y(休 2) | 2028038.IB | 20 中国银行二级 01  | AAA     | 3.27%  |
| 2.59Y+5Y      | 2028041.IB | 20 工商银行二级 01  | AAA     | 3.27%  |
| 2.7Y+5Y(休 1)  | 2028044.IB | 20 广发银行二级 01  | AAA     | 3.50%  |
| 2.7Y+5Y(休 1)  | 2028044.IB | 20 广发银行二级 01  | AAA     | 3.50%  |
| 2.7Y+5Y(休 1)  | 2028044.IB | 20 广发银行二级 01  | AAA     | 3.405% |
| 2.74Y         | 2220079.IB | 22 江苏银行       | AAA     | 2.97%  |
| 3.07Y+5Y      | 2128008.IB | 21 中国银行二级 01  | AAA     | 3.40%  |
| 3.08Y+NY      | 2128011.IB | 21 邮储银行永续债 01 | AAA     | 3.65%  |
| 3.08Y+NY      | 2128011.IB | 21 邮储银行永续债 01 | AAA     | 3.57%  |
| 3.08Y+NY      | 2128011.IB | 21 邮储银行永续债 01 | AAA     | 3.57%  |
| 3.3Y+NY       | 2128021.IB | 21 工商银行永续债 01 | AAA     | 3.68%  |
| 3.47Y+5Y(休 1) | 2128025.IB | 21 建设银行二级 01  | AAA     | 3.45%  |
| 3.47Y+5Y(休 1) | 2128025.IB | 21 建设银行二级 01  | AAA     | 3.45%  |
| 3.6Y+5Y(休 2)  | 2128030.IB | 21 交通银行二级     | AAA     | 3.48%  |
| 3.66Y+NY      | 2120089.IB | 21 北京银行永续债 01 | AAA     | 3.95%  |
| 3.72Y+5Y(休 1) | 2128033.IB | 21 建设银行二级 03  | AAA     | 3.55%  |
| 3.74Y+5Y(休 1) | 2128039.IB | 21 中国银行二级 03  | AAA     | 3.60%  |
| 3.74Y+NY      | 2128038.IB | 21 农业银行永续债 01 | AAA     | 3.76%  |
| 3.76Y+5Y      | 2128042.IB | 21 兴业银行二级 02  | AAA     | 3.72%  |
| 3.76Y+5Y      | 2128042.IB | 21 兴业银行二级 02  | AAA     | 3.72%  |

|               |              |                 |         |       |
|---------------|--------------|-----------------|---------|-------|
| 3.76Y+5Y      | 2128042.IB   | 21 兴业银行二级 02    | AAA     | 3.72% |
| 3.76Y+5Y      | 2128042.IB   | 21 兴业银行二级 02    | AAA     | 3.70% |
| 3.76Y+5Y      | 2128042.IB   | 21 兴业银行二级 02    | AAA     | 3.70% |
| 3.76Y+NY      | 2128044.IB   | 21 工商银行永续债 02   | AAA     | 3.80% |
| 3.77Y+NY(休 1) | 2128045.IB   | 21 中国银行永续债 02   | AAA     | 3.76% |
| 3.9Y+5Y       | 2228003.IB   | 22 兴业银行二级 01    | AAA     | 3.70% |
| 3.9Y+5Y       | 2228003.IB   | 22 兴业银行二级 01    | AAA     | 3.70% |
| 4.18Y+2Y      | 2280202.IB   | 22 望城经开 02      | AA+     | 4.82% |
| 4.31Y         | 184426.SH    | G22 厦 01        | AAA     | 3.35% |
| 4.31Y         | 184426.SH    | G22 厦 01        | AAA     | 3.35% |
| 4.32Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01    | AAA     | 3.66% |
| 4.32Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01    | AAA     | 3.65% |
| 4.32Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01    | AAA     | 3.63% |
| 4.33Y+5Y      | 2228041.IB   | 22 农业银行二级 01    | AAA     | 3.62% |
| 4.33Y+5Y      | 2228041.IB   | 22 农业银行二级 01    | AAA     | 3.62% |
| 4.38Y+5Y      | 092280014.IB | 22 上海银行二级资本债 01 | AAA     | 3.82% |
| 4.38Y+5Y      | 092280014.IB | 22 上海银行二级资本债 01 | AAA     | 3.80% |
| 4.39Y         | 1780144.IB   | 17 铁道 13        | AAA     | 3.00% |
| 4.45Y+5Y      | 092280033.IB | 22 宁波银行二级资本债 01 | AAA     | 3.82% |
| 4.51Y+5Y      | 092280069.IB | 22 华夏银行二级资本债 01 | AAA     | 3.82% |
| 4.51Y+5Y      | 092280069.IB | 22 华夏银行二级资本债 01 | AAA     | 3.80% |
| 4.52Y(休 1)    | 137724.SH    | 22 沪国 03        | AAA     | 3.40% |
| 4.53Y+NY      | 092280083.IB | 22 建行永续债 01     | AAA     | 3.90% |
| 4.54Y+NY(休 1) | 092280086.IB | 22 农行永续债 02     | AAA     | 3.93% |
| 4.54Y+NY(休 1) | 092280086.IB | 22 农行永续债 02     | AAA     | 3.91% |
| 4.85Y+5Y      | 232280012.IB | 22 广州银行二级资本债 01 | AAA/AA+ | 4.52% |
| 9.59Y+5Y      | 092200009.IB | 22 农行二级资本债 02B  | AAA     | 3.74% |
| 19D(休 2)      | 032100297.IB | 21 洛阳城乡 PPN001  | AA+     | 3.27% |
| 73D+1.99Y     | 032000435.IB | 20 郾国投 PPN001   | AA      | 4.10% |
| 286D(休 1)     | 032001018.IB | 20 杭州湾新 PPN001  | AA+     | 3.25% |
| 286D(休 1)     | 032191345.IB | 21 丰城发投 PPN002  | AA+     | 4.44% |
| 344D          | 031900114.IB | 19 南昌水投 PPN001  | AAA     | 3.30% |
| 1.04Y         | 031900157.IB | 19 青岛城投 PPN001  | AAA     | 3.34% |
| 1.08Y         | 031900214.IB | 19 青岛城投 PPN002  | AAA     | 3.32% |

|            |              |                |     |       |
|------------|--------------|----------------|-----|-------|
| 1.34Y+2Y   | 032100690.IB | 21 海盐国资 PPN003 | AA+ | 3.47% |
| 1.49Y(休 1) | 032100872.IB | 21 锡西新城 PPN001 | AA  | 3.86% |

文 / Derek Huang, Ethan Yuan, Teddy Chen, Oscar Wu

联系人: Yolanda Fang  
邮箱: Yolanda.Fang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所念及附加的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 或第三方, “信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、时效性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN